

弘毅远方港股通智选领航混合型发起式
证券投资基金清算报告

基金管理人:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告出具日期: **2024** 年 **3** 月 **1** 日

报告公告日期: **2024** 年 **3** 月 **5** 日

一、重要提示

弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3447号《关于准予弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金募集注册的批复》准予募集注册，于2021年2月8日成立并正式运作。本基金的基金管理人为弘毅远方基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“本基金的《基金合同》生效三年后（指《基金合同》生效之日起三年后的对应日，该对应日如为非工作日，则自动顺延至下一个工作日），若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”因2024年2月8日基金资产净值低于两亿元触发《基金合同》约定的终止情形，本基金管理人决定终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。详见本基金管理人于2024年2月9日发布的《关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金最后运作日为2024年2月8日，自2024年2月9日起，本基金进入清算程序，本基金清算期自2024年2月9日至2024年3月1日止，由基金管理人弘毅远方基金管理有限公司、基金托管人浙商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2024年2月9日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金
------	-------------------------

基金简称	弘毅远方港股通智选领航混合	
基金主代码	011157	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年02月08日	
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
最后运作日(2024年2月8日) 基金份额总额	62,319,964.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	弘毅远方港股通智选领航混合A	弘毅远方港股通智选领航混合C
下属分级基金的交易代码	011157	011158
报告期末下属分级基金的份 额总额	33,360,149.42份	28,959,814.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过持续、深入、系统、全面的产业及基本面研究，叠加大数据工具的使用，在沪港深市场内，参考全球投资者通用的核心资产定价标准，挖掘具有发展潜力和估值优势的引领创新及升级的优质公司。在严格控制基本面风险、流动性风险及估值风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金紧密跟踪国内外市场环境变化，通过对各个主要经济体的运行态势、央行政策变化、证券市场状况、国际资金及情绪动态等因素的紧密跟踪及深入研究，自上而下的判断宏观经济运行周期及发展趋势，分析评估各类资产与市场的风险和预期收益，确定不同市场间股票、现金等大类资产的配置比例，并适时进行调整。与此同时，深入了解各行业状况、以自下而上的视角，挖掘行业的价值性和成长性，结合对基本面与走势趋势性的把握，综合评估产业在不同时间段、不同市场间的风险收益水平。采用动态策略，适时调整资产配置比例，有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益，力求实现基金财产的长期稳定增值。

	本基金对于港股通标的股票的投资，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。
业绩比较基准	恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，而低于股票型基金。本基金投资港股通标的股票，将需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 2 月 8 日

单位：人民币元

资 产	本期末
资 产：	
银行存款	18,519,902.33
结算备付金	22,342.17
存出保证金	-
交易性金融资产	17,442,605.59
其中：股票投资	17,442,605.59
应收清算款	5,997,707.94
应收股利	-
其他资产	-
资产总计	41,982,558.03
负债和净资产	本期末
负 债：	
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-

应付赎回款	14,862,428.77
应付管理人报酬	14,894.76
应付托管费	2,482.45
应付销售服务费	2,402.45
应交税费	-
其他负债	216,644.68
负债合计	15,098,853.11
净资产：	
实收基金	62,319,964.24
其他综合收益	-
未分配利润	-35,436,259.32
净资产合计	26,883,704.92
负债和净资产总计	41,982,558.03

注：报告截止日 2024 年 2 月 8 日（基金最后运作日），本基金 A 类基金份额净值 0.4344 元，基金份额为 33,360,149.42 份；C 类基金份额净值 0.4279 元，基金份额为 28,959,814.82 份。

四、清盘事项说明

1、基本情况

弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3447 号《关于准予弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由弘毅远方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 717,658,924.18 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0110 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 717,738,823.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 79,899.71 份基金份额。本基金的基金管理人为弘毅远方基

金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,138.90 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产的比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%。

2、清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“本基金的《基金合同》生效三年后（指《基

金合同》生效之日起三年后的对应日，该对应日如为非工作日，则自动顺延至下一个工作日），若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”因 2024 年 2 月 8 日基金资产净值低于 2 亿元触发《基金合同》约定的终止情形，本基金管理人决定终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。详见本基金管理人于 2024 年 2 月 9 日发布的《关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

3、清算起始日

根据《关于弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金自 2024 年 2 月 9 日起进入清算程序。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。基金管理人编制本清算报表是为了弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金财产清算小组报送弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金全体持有人以及中国证券监督管理委员会使用。因此，本清算报表不适用于其他用途。

五、清算情况

自 2024 年 2 月 9 日至 2024 年 3 月 1 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清

算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为 18,519,902.33 元，其中银行托管户 7,358,235.33 元，证券户 11,156,466.80 元，另包含应计利息 5,200.20 元，其中托管户利息 1,685.34 元，证券户利息 3,514.86 元。清算期间，银行托管户计提利息 2,123.30 元，证券户计提利息 1,268.12 元。截至清算期结束日，应计银行托管户利息余额为 3,808.64 元，应计证券户利息余额为 4,782.98 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为 22,342.17 元，其中期货备付金 18,695.31 元，应计利息 3,646.86 元。清算期间，计提利息 4.94 元。截至清算期结束日，应计利息余额为 3,651.80 元。

(3) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为 17,442,605.59 元，全部为股票投资。截止清盘结束，本基金所持其余股票均已卖出，卖券变现产生的证券清算款为人民币 16,436,243.60 元，该款项已于 3 月 1 日前划入基金托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理费为 14,894.76 元，该款项已于 2024 年 3 月 1 日前支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 2,482.45 元，该款项已于 2024 年 3 月 1 日前支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为 2,402.45 元，该款项已于 2024 年 3 月 1 日前支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为 216,644.68 元，其中应付赎回费 1,713.17 元，；应付审计费用 66,000.00 元，应付信息披露 148,931.51 元。应付赎回费已于 2024 年 3 月 1 日前支付，其他款项将于清算期间结束后支付。

4、申赎变动情况

投资者于 2024 年 2 月 8 日申请赎回 14,682,148.05 份基金份额，合计减少实收基金 14,682,148.05 份，合计赎回金额 6,329,090.22 元

5、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	2024 年 2 月 9 日 至 2024 年 3 月 1 日 止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	589,556.94
利息收入（注 1）	3,396.36
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	585,897.50
其他收入（注 3）	263.08
二、清算期间费用	15,000.00
律师费	15,000.00
二、清算期间净收益	574,556.94

注 1：利息收入系清算期间计提的托管户、证券户、期货账户存款利息。

注 2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日的股票估值总额并扣除交易费用后的差额。

注 3：其他收入系 2024 年 2 月 19 日确认的赎回费归基金资产所产生的收入。

6、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项 目	金 额
一、最后运作日 2024 年 2 月 8 日基金净资产	26,883,704.92
加：清算期间净赎回	- 6,329,090.22
加：清算期间净收益	574,556.94
二、2024 年 3 月 1 日基金净资产	21,129,171.64

注：资产处置及负债清偿后，2024 年 3 月 1 日本基金剩余财产为 21,129,171.64 元。根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。本次清算分配金额为剩余财产扣除待申购新股款和应收利息后的金额人民币 21,129,171.64 元，本基金 A 类基金清算分配金额 11,695,438.74 元，本基金 C 类基金清算分配金额 9,433,732.90 元。

基金管理人将以自有资金垫付应收利息等资产，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。清算期结束日后至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，在支付清算款时将一并计算并支付给份额持有人。

7、基金财产清算报告的告知安排

清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1)《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2)上海市通力律师事务所关于《弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

弘毅远方港股通智选领航混合型发起式证券投资基金财产清算小组

2024年3月1日